

## 上证细分信用等级可转债及可交换债券指数系列编制方案

上证细分信用等级可转债及可交换债券指数系列从上海证券交易所上市的可转换公司债券和可交换公司债券中，分别选取相应信用评级的债券作为指数样本，以反映相应信用等级可转债及可交换债的整体表现。

### 一、指数名称和代码

指数名称	指数简称	英文名称	英文简称	指数代码
上证 AAA 可转债及可交换债券指数	沪 AAA 转债及可交换债	SSE AAA Convertible Bond and Exchangeable Bond Index	SSE AAA Convertible Bond and Exchangeable Bond	950365
上证高等级可转债及可交换债券指数	沪高等级转债及可交换债	SSE High Grade Convertible Bond and Exchangeable Bond Index	SSE High Grade Convertible Bond and Exchangeable Bond	950367
上证中高等级可转债及可交换债券指数	沪中高等级转债及可交换债	SSE Medium-High Grade Convertible Bond and Exchangeable Bond Index	SSE Medium-High Grade Convertible Bond and Exchangeable Bond	950366

### 二、指数基日和基点

该指数系列以 2016 年 12 月 30 日为基日，以 100 点为基点。

### 三、样本选取方法

#### 1、样本空间

该指数系列的样本空间由满足以下条件的债券构成：

(1) 债券种类：在上海证券交易所上市的可转换公司债券和可交换公司债券且正股非 ST、\*ST，不含私募债和永续债，债券币种为人民币；

(2) 付息方式：固定利率付息或一次还本付息。

#### 2、选样方法

在样本空间中，选取信用评级符合如下条件的债券作为各指数样本：

指数代码	指数简称	信用评级
950365	沪 AAA 转债及可交换债	AAA
950367	沪高等级转债及可交换债	AA+及以上
950366	沪中高等级转债及可交换债	AA 及以上

### 四、指数计算

指数采用派许加权综合价格指数方法计算，计算公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本债券总市值}}{\text{除数}} \times 100$$

其中，报告期样本总市值 =  $\sum$  [(净价 + 应计利息) × 发行量]。

该指数系列计算用价格为交易价格，其他计算用数据、除数调整参见计算与维护细则。

## 五、样本调整

### 1、定期调整

该指数系列样本每月调整一次，定期调整生效日为每月首个交易日。

### 2、临时调整

若样本发生摘牌等事件，视情况自事件生效之日起剔除出指数；若样本发行人发布赎回公告，自赎回公告日后第五个交易日将该券剔除出指数；样本发生其他事件，参照计算与维护细则处理。